



DAFTAR ISI

Pernyataan	ii
Kata Pengantar	iv
Daftar Tabel	ix
Abstract	x
Intisari	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Pertanyaan Penelitian	6
1.4 Tujuan Penelitian.....	6
1.5 Manfaat Penelitian.....	7
1.6 Lingkup Penelitian	7
1.7 Sistematika Penulisan.....	8
BAB II LANDASAN TEORI	10
2.1 Investasi.....	10
2.2 Pasar Modal.....	11
2.3 Teori Efisiensi Pasar.....	12
2.3.1 <i>Weak Form</i>	13



2.3.2	<i>Semi-strong Form</i>	14
2.3.3	<i>Strong Form</i>	15
2.4	Anomali Pasar	15
2.4.1	<i>Earnings Announcement Effect</i>	17
2.4.2	<i>January Effect</i>	17
2.4.3	<i>Day of the Week Effect</i>	18
2.4.4	<i>Size Effect</i>	19
2.5	<i>Mental Accounting</i>	21
2.6	Penelitian Terdahulu	24
2.7	Hipotesis Penelitian.....	26
BAB III METODA PENELITIAN.....		30
3.1	Data dan Sumber Data.....	30
3.2	Perumusan Model dan Variabel Penelitian	32
3.2.1	Kapitalisasi	32
3.2.2	Perumusan Model.....	35
3.2.3	Variabel Operasional Penelitian.....	37
3.3	Populasi dan Sampel	38
3.4	Metoda Analisis Data	39
3.4.1	Hipotesis Pertama (H_1).....	39
3.4.2	Hipotesis Kedua (H_2)	41



BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	43
4.1 Deskripsi Data	43
4.2 Pengujian Hipotesis	45
4.2.1. Hasil Pengujian terhadap Hipotesis Pertama (H_1).....	45
4.2.2. Hasil Pengujian terhadap Hipotesis kedua (H_2)	47
4.3 Diskusi dan Pembahasan	49
4.3.1. Pengaruh <i>size</i> terhadap <i>return</i> berdasarkan kapitalisasi	49
4.3.2. Pengaruh <i>risk</i> terhadap <i>return</i> berdasarkan volatilitas	50
BAB V SIMPULAN	54
5.1. Simpulan.....	54
5.2. Implikasi	55
5.2.1. Implikasi Teoritis	55
5.2.2. Implikasi Praktis.....	56
5.3. Keterbatasan	56
5.4. Saran.....	57
DAFTAR PUSTAKA	58